

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44

8.2 期末上市基金前十名持有人	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	45
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	48
11 影响投资者决策的其他重要信息	50
12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金		
基金简称	国联安双禧中证 100 指数分级		
场内简称	双禧 100		
基金主代码	162509		
交易代码	162509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 4 月 16 日		
基金管理人	国联安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	175,949,635.27 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2010 年 6 月 18 日		
下属分级基金的基金简称	国联安双禧 A 中证 100 指数	国联安双禧 B 中证 100 指数	国联安双禧中证 100 指数
下属分级基金的场内简称	中证 100A	中证 100B	双禧 100
下属分级基金的交易代码	150012	150013	162509
报告期末下属分级基金的份额总额	26,251,404.00 份	39,377,106.00 份	110,321,125.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中证 100 指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。		
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现中证 100 指数的有效跟踪。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	95%×中证 100 指数收益率+5%×活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。		
下属分级基金的风险	中证 100A：低风险低	中证 100B：高风险高	双禧 100：本基金为被

收益特征	收益。	收益。	动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
------	-----	-----	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	李申
	联系电话	021-38992888	021-60637102
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	021-60637111
传真		021-50151582	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		于业明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场23层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
---------------	---------------------------

本期已实现收益	12,605,892.73
本期利润	4,531,704.53
加权平均基金份额本期利润	0.0242
本期加权平均净值利润率	2.31%
本期基金份额净值增长率	2.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	83,167,293.31
期末可供分配基金份额利润	0.4727
期末基金资产净值	197,141,410.85
期末基金份额净值	1.120
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	72.87%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益包含停牌股票按公允价值调整的影响；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.80%	0.87%	5.86%	0.88%	1.94%	-0.01%
过去三个月	13.59%	0.82%	10.17%	0.82%	3.42%	0.00%
过去六个月	2.85%	1.38%	-2.62%	1.40%	5.47%	-0.02%
过去一年	12.22%	1.12%	2.23%	1.13%	9.99%	-0.01%
过去三年	28.86%	1.18%	15.78%	1.20%	13.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	72.87%	1.37%	30.28%	1.38%	42.59%	-0.01%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 4 月 16 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ ；

2、本基金基金合同于 2010 年 4 月 16 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，2010 年 10 月 15 日建仓期结束当日除股票投资比例略低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定；

3、本基金于 2010 年 6 月 18 日已基本建仓完毕，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值 90%，其他各项资产配置比例自该日起均符合基金合同的约定。由于 2010 年 10 月 15 日有连续大额申购从而导致股票投资比例当日被动未达标，本基金已于 2010 年 10 月 20 日及时调整完毕；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理五十四只开放式基金。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理、国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资	2010-04-16	-	17 年（自 2002 年起）	黄欣先生，硕士研究生。2003 年 10 月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理。现任量化投资部总监助理。2010 年 4 月起担任国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金的基金经理，2010 年 5 月至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理，2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2013 年 6 月至 2017 年 3 月兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金经理，2018 年 3 月至 2019 年 7 月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 5 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 6 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指

	基金联接基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。				数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 11 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 12 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	---	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统内的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，突如其来新冠疫情给人类的生活以及宏观经济带来了巨大的冲击，中美之间的贸易摩擦在疫情爆发的大环境下更是不断升级。经过一季度严格的防疫措施之后，国内开始复工复产，经济逐步向正常水平恢复。国外特别是美国的情况却不令人乐观，受感染人数在不断上升，经济全面重启遥遥无期。A 股在疫情出现后出现大幅的下跌，但是随着疫情在国内被有效抑制，经济出现反弹，二季度的股市也出现较大幅度的上涨，小盘股票表现分化较大，小盘股表现相对较好。从整个上半年来看，沪深 300 指数上涨 1.64%，中证 100 指数下跌 2.83%，而中小板综指上涨 15.14%，创业板综指上涨 27.94%。从板块表现来看，上半年医药、半导体、食品饮料等行业板块表现较好。

本报告期内，双禧基金始终保持较高的仓位，采用完全复制的方法跟踪中证 100 指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.1200 元，本报告期份额净值增长率为 2.85%，同期业绩比较基准收益率为-2.62%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.07%，年化跟踪误差为 1.20%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，以及年化跟踪误差不超过 4.0%的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 下半年，新冠疫情、美国特朗普政府的对华政策等因素给全球的宏观经济带来较大的不确定性。但是可以确定的是，由于应对疫情得力，中国率先全面复工复产，A 股资产在全球范围内势必是较好的投资选择。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和

基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及本基金基金合同的约定，本基金（包括双禧 100 份额、双禧 A 份额、双禧 B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	13,616,744.11	12,477,786.85
结算备付金		-	-
存出保证金		8,886.50	18,807.65
交易性金融资产	6.4.7.2	183,876,380.72	208,098,099.12
其中：股票投资		183,876,380.72	208,098,099.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		388,459.26	820,890.82
应收利息	6.4.7.5	2,645.27	2,818.95
应收股利		-	-
应收申购款		9,014.54	3,376.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		197,902,130.40	221,421,779.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		408,893.76	148,845.95
应付管理人报酬		158,122.35	182,592.82
应付托管费		34,786.91	40,170.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	28,811.75	27,034.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,104.78	191,297.60
负债合计		760,719.55	589,940.96
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	113,974,117.54	131,345,578.18

未分配利润	6.4.7.10	83,167,293.31	89,486,260.36
所有者权益合计		197,141,410.85	220,831,838.54
负债和所有者权益总计		197,902,130.40	221,421,779.50

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 175,949,635.27 份，其中国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之基础份额 110,321,125.27 份，基金份额净值 1.120 元；国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 A 份额 26,251,404.00 份，基金份额参考净值 1.061 元；国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 B 份额 39,377,106.00 份，基金份额参考净值 1.159 元。

6.2 利润表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		5,989,435.05	40,095,639.48
1.利息收入		45,858.04	38,384.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,858.04	38,384.10
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,983,685.52	10,590,226.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	11,779,704.40	8,864,228.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,203,981.12	1,725,998.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,074,188.20	29,383,092.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	34,079.69	83,936.08
减：二、费用		1,457,730.52	1,151,573.18
1. 管理人报酬		978,462.62	755,625.10
2. 托管费		215,261.81	166,237.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	123,940.77	86,289.37

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	140,065.32	143,421.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,531,704.53	38,944,066.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,531,704.53	38,944,066.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	131,345,578.18	89,486,260.36	220,831,838.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,531,704.53	4,531,704.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,371,460.64	-10,850,671.58	-28,222,132.22
其中：1.基金申购款	301,578.12	185,494.78	487,072.90
2.基金赎回款	-17,673,038.76	-11,036,166.36	-28,709,205.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	113,974,117.54	83,167,293.31	197,141,410.85
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	118,624,692.24	24,499,530.24	143,124,222.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,944,066.30	38,944,066.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-22,976,564.53	-11,710,570.61	-34,687,135.14

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	512,884.21	226,685.23	739,569.44
2.基金赎回款	-23,489,448.74	-11,937,255.84	-35,426,704.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	95,648,127.71	51,733,025.93	147,381,153.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：魏东，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 228 号《关于核准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 982,019,785.35 元，业经毕马威华振会计师事务所 KPMG-B(2010) CR No. 0017 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 982,138,906.44 份，其中认购资金利息折合 119,121.09 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国联安双禧中证 100 份额”)、国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“国联安双禧中证 100A 份额”)及国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“国联安双禧中证 100B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售国联安双禧中证 100 份额。投资人场外认购所得的国联安双禧中证 100 份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的国联安双禧中证 100 份额，将按 4：6 的基金份额配比自动分离为国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额。国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额的数量保持 4：6 的比例不变。基金合同生效后，国联安双禧中证 100 份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足

上市条件的情况下，国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内国联安双禧中证 100 份额与国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 10 份场内国联安双禧中证 100 份额按照 4：6 的份额配比转换成 4 份国联安双禧中证 100A 份额与 6 份国联安双禧中证 100B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 4 份国联安双禧中证 100A 份额与 6 份国联安双禧中证 100B 份额按照 4：6 的基金份额配比转换成 10 份场内国联安双禧中证 100 份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：国联安双禧中证 100 份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为国联安双禧中证 100 份额、国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额数量的总和。本基金每 4 份国联安双禧中证 100A 份额与每 6 份国联安双禧中证 100B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 10 份国联安双禧中证 100 份额的基金份额净值之和。国联安双禧中证 100A 份额的约定收益率为一年期银行定期存款年利率加上 3.5%，国联安双禧中证 100A 份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出国联安双禧中证 100A 份额的基金份额参考净值后，根据国联安双禧中证 100 份额的基金份额净值与国联安双禧中证 100A 份额、国联安双禧中证 100B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出国联安双禧中证 100B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行基金份额到期折算和基金份额到点折算。在本基金存续期内，自上一基金份额折算日次日或基金合同生效日始至满三年的最后工作日止，如果期间每个工作日国联安双禧中证 100B 份额的份额净值都大于 0.150 元，则以最后工作日为基金份额折算日实施到期折算；如果期间某个工作日国联安双禧中证 100B 份额的份额净值小于或等于 0.150 元，则以该日后的第二个工作日为基金份额折算日实施到点折算。经过上述份额折算，国联安双禧中证 100 份额的基金份额净值、国联安双禧中证 100A 份额与国联安双禧中证 100B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]193 号文核准，本基金国联安双禧中证 100A 份额 263,081,728 份基金份额与国联安双禧中证 100B 份额 394,622,592 份基金份额于 2010 年 6 月 18 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的国联安双禧 100 份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额即可上市流通；对于托管在场外的国联安双禧中证 100 份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数的成份股、备选成份股、新股、现金和到期日在一年以内的政府债券等。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：95%×中证 100 指数收益率+5%×活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	13,616,744.11
定期存款	-
其他存款	-

合计	13,616,744.11
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	147,026,590.38	183,876,380.72	36,849,790.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	147,026,590.38	183,876,380.72	36,849,790.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,641.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孖息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.00
合计	2,645.27

注：此处其他列示的是基金上交所和深交所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	28,811.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	28,811.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,426.69
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	9,335.23
预提审计费	29,835.26
预提信息披露费	59,672.34
预提上市年费	29,835.26
合计	130,104.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,770,750.80	131,345,578.18

本期申购	465,562.78	301,578.12
本期赎回（以“-”号填列）	-27,286,678.31	-17,673,038.76
本期末	175,949,635.27	113,974,117.54

注：本基金的基金份额包括国联安双禧中证 100 份额、国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额。本期申购含申购的国联安双禧中证 100 份额和配对转入的国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额，本期赎回含赎回的国联安双禧中证 100 份额和配对转出的国联安双禧中证 100A 份额和国联安双禧中证 100B 份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	119,689,686.97	-30,203,426.61	89,486,260.36
本期利润	12,605,892.73	-8,074,188.20	4,531,704.53
本期基金份额交易产生的变动数	-16,543,508.99	5,692,837.41	-10,850,671.58
其中：基金申购款	287,311.43	-101,816.65	185,494.78
基金赎回款	-16,830,820.42	5,794,654.06	-11,036,166.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,752,070.71	-32,584,777.40	83,167,293.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	45,617.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	138.34
其他	101.77
合计	45,858.04

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	43,587,036.94
减：卖出股票成本总额	31,807,332.54

买卖股票差价收入	11,779,704.40
----------	---------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

报告期内本基金本无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,203,981.12
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,203,981.12

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-8,074,188.20
——股票投资	-8,074,188.20
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-8,074,188.20

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	34,077.02
转换费收入	2.67
合计	34,079.69

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	123,940.77
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	123,940.77

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款费用	1,153.24
上市费	29,835.26
指数使用费	19,569.22
合计	140,065.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无应支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	978,462.62	755,625.10
其中：支付销售机构的客户维护费	80,254.32	87,810.90

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	215,261.81	166,237.59

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方发生转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末，除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,616,744.11	45,617.93	8,755,754.41	38,232.33

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2020 年 6 月 30 日无相关余额（2019 年 6 月 30 日余额：人民币 2,585.99 元）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股待上市	16.42	16.42	4,872	79,998.24	79,998.24	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股待上市	11.33	11.33	7,346	83,230.18	83,230.18	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股待上市	15.50	15.50	4,693	72,741.50	72,741.50	-
688177	百奥泰	2020-02-13	2020-08-21	新股锁定	32.76	57.02	6,556	214,774.56	373,823.12	-
688228	开普云	2020-03-19	2020-09-28	新股锁定	59.26	73.20	1,522	90,193.72	111,410.40	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股待上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股待上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安	2020-06-23	2020-07-02	新股待上市	17.63	17.63	470	8,286.51	8,286.51	-

	高科	6-24	7-03	上市				10	10	
300846	首都 在线	2020-0 6-22	2020-0 7-01	新股待 上市	3.37	3.37	1,131	3,811. 47	3,811. 47	-
688027	国盾 量子	2020-0 6-30	2020-0 7-09	新股待 上市	36.18	36.18	2,122	76,773 .96	76,773 .96	-
688277	天智 航	2020-0 6-24	2020-0 7-07	新股待 上市	12.04	12.04	8,502	102,36 4.08	102,36 4.08	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0%（上年度 2019 年 12 月 31 日：0%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.47%。

本基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 196,954,588.63 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,616,744.11	-	-	-	-	-	13,616,744.11
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	8,886.50	-	-	-	-	-	8,886.50
交易性金融资产	-	-	-	-	-	183,876,380.72	183,876,380.72
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	388,459.26	388,459.26
应收利息	-	-	-	-	-	2,645.27	2,645.27
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	9,014.54	9,014.54
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,625,630.61	-	-	-	-	184,276,499.79	197,902,130.40
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回	-	-	-	-	-	408,893.76	408,893.76

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	158,122.35	158,122.35
应付托管费	-	-	-	-	-	34,786.91	34,786.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	28,811.75	28,811.75
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	130,104.78	130,104.78
负债总计	-	-	-	-	-	760,719.55	760,719.55
利率敏感度缺口	13,625,630.61	-	-	-	-	183,515,780.24	197,141,410.85
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,477,786.85	-	-	-	-	-	12,477,786.85
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	18,807.65	-	-	-	-	-	18,807.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	208,098,099.12	208,098,099.12
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	820,890.82	820,890.82
应收利息	-	-	-	-	-	2,818.95	2,818.95
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	3,376.11	3,376.11
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,496,594.50	-	-	-	-	208,925,185.00	221,421,779.50
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	148,845.95	148,845.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	182,592.82	182,592.82

应付托管费	-	-	-	-	-	40,170.43	40,170.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	27,034.16	27,034.16
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	191,297.60	191,297.60
负债总计	-	-	-	-	-	589,940.96	589,940.96
利率敏感度缺口	12,496,594.50	-	-	-	-	208,335,244.04	220,831,838.54

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0%(2019 年 12 月 31 日：0%)，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析(2019 年 12 月 31 日：同)。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金管理人定期结合宏

观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	183,876,380.72	93.27	208,098,099.12	94.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	183,876,380.72	93.27	208,098,099.12	94.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 9,719,581.74	增加 10,933,073.93
	业绩比较基准下降 5%	减少 9,719,581.74	减少 10,933,073.93

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	183,876,380.72	92.91
	其中：股票	183,876,380.72	92.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,616,744.11	6.88
8	其他各项资产	409,005.57	0.21
9	合计	197,902,130.40	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,186,076.00	2.12
B	采矿业	4,858,223.77	2.46
C	制造业	72,893,342.40	36.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,129,985.18	2.09
E	建筑业	4,406,447.91	2.24
F	批发和零售业	1,302,140.40	0.66

G	交通运输、仓储和邮政业	4,494,239.32	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,098,592.72	1.06
J	金融业	69,283,067.92	35.14
K	房地产业	7,334,720.32	3.72
L	租赁和商务服务业	3,936,952.68	2.00
M	科学研究和技术服务业	1,906,111.20	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	357,975.00	0.18
Q	卫生和社会工作	1,662,397.00	0.84
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	182,850,271.82	92.75

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	889,834.61	0.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,507.97	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,026,108.90	0.52

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	205,858	14,698,261.20	7.46
2	600519	贵州茅台	9,588	14,026,093.44	7.11
3	600036	招商银行	196,004	6,609,254.88	3.35
4	600276	恒瑞医药	70,629	6,519,056.70	3.31
5	000858	五 粮 液	36,853	6,306,285.36	3.20
6	000333	美的集团	93,060	5,564,057.40	2.82
7	000651	格力电器	91,412	5,171,176.84	2.62
8	002475	立讯精密	79,578	4,086,330.30	2.07
9	600030	中信证券	161,844	3,902,058.84	1.98
10	601166	兴业银行	236,818	3,736,988.04	1.90
11	600887	伊利股份	115,300	3,589,289.00	1.82
12	000002	万 科 A	129,368	3,381,679.52	1.72
13	601398	工商银行	665,990	3,316,630.20	1.68
14	600900	长江电力	168,147	3,184,704.18	1.62
15	601888	中国中免	18,500	2,849,555.00	1.45
16	601328	交通银行	522,097	2,678,357.61	1.36
17	300059	东方财富	122,490	2,474,298.00	1.26
18	600585	海螺水泥	45,635	2,414,547.85	1.22
19	000725	京东方 A	514,776	2,404,003.92	1.22
20	000001	平安银行	184,380	2,360,064.00	1.20

21	600000	浦发银行	223,067	2,360,048.86	1.20
22	002714	牧原股份	28,500	2,337,000.00	1.19
23	601336	新华保险	52,525	2,325,807.00	1.18
24	603288	海天味业	18,460	2,296,424.00	1.16
25	600016	民生银行	404,308	2,292,426.36	1.16
26	002415	海康威视	70,980	2,154,243.00	1.09
27	600031	三一重工	112,200	2,104,872.00	1.07
28	601688	华泰证券	111,870	2,103,156.00	1.07
29	000063	中兴通讯	51,217	2,055,338.21	1.04
30	600048	保利地产	136,060	2,010,966.80	1.02
31	600837	海通证券	153,795	1,934,741.10	0.98
32	603259	药明康德	19,732	1,906,111.20	0.97
33	601668	中国建筑	398,743	1,902,004.11	0.96
34	300498	温氏股份	84,820	1,849,076.00	0.94
35	601288	农业银行	545,925	1,845,226.50	0.94
36	300015	爱尔眼科	38,260	1,662,397.00	0.84
37	601229	上海银行	189,002	1,568,716.60	0.80
38	002142	宁波银行	57,050	1,498,703.50	0.76
39	600309	万华化学	29,800	1,489,702.00	0.76
40	601211	国泰君安	85,700	1,479,182.00	0.75
41	601988	中国银行	400,465	1,393,618.20	0.71
42	002352	顺丰控股	25,200	1,378,440.00	0.70
43	601169	北京银行	281,177	1,377,767.30	0.70
44	600009	上海机场	18,300	1,318,881.00	0.67
45	601766	中国中车	231,149	1,287,499.93	0.65
46	600690	海尔智家	71,904	1,272,700.80	0.65
47	000568	泸州老窖	13,900	1,266,568.00	0.64
48	002594	比亚迪	17,210	1,235,678.00	0.63
49	002304	洋河股份	11,405	1,199,121.70	0.61
50	600999	招商证券	54,312	1,192,148.40	0.60
51	601899	紫金矿业	261,265	1,149,566.00	0.58
52	600104	上汽集团	66,632	1,132,077.68	0.57
53	002027	分众传媒	195,224	1,087,397.68	0.55
54	601818	光大银行	302,632	1,083,422.56	0.55
55	600919	江苏银行	175,500	995,085.00	0.50
56	600028	中国石化	254,236	994,062.76	0.50
57	001979	招商蛇口	60,200	989,688.00	0.50
58	000538	云南白药	9,688	908,831.28	0.46
59	601088	中国神华	62,700	900,372.00	0.46
60	600406	国电南瑞	43,900	888,975.00	0.45
61	000895	双汇发展	18,899	871,054.91	0.44
62	000166	申万宏源	171,278	864,953.90	0.44
63	601628	中国人寿	31,674	861,849.54	0.44
64	600050	中国联通	176,908	856,234.72	0.43

65	601009	南京银行	114,100	836,353.00	0.42
66	601006	大秦铁路	113,023	795,681.92	0.40
67	000776	广发证券	56,194	793,459.28	0.40
68	603160	汇顶科技	3,500	780,150.00	0.40
69	601390	中国中铁	154,766	776,925.32	0.39
70	601857	中国石油	184,566	773,331.54	0.39
71	600019	宝钢股份	169,318	772,090.08	0.39
72	601186	中国铁建	87,432	732,680.16	0.37
73	600015	华夏银行	116,990	715,978.80	0.36
74	601989	中国重工	173,330	693,320.00	0.35
75	601933	永辉超市	72,700	681,926.00	0.35
76	002024	苏宁易购	70,720	620,214.40	0.31
77	601138	工业富联	37,800	572,670.00	0.29
78	600346	恒力石化	40,100	561,400.00	0.28
79	601225	陕西煤业	76,007	548,010.47	0.28
80	002736	国信证券	46,700	527,710.00	0.27
81	600340	华夏幸福	22,900	523,494.00	0.27
82	601669	中国电建	145,365	502,962.90	0.26
83	603993	洛阳钼业	134,300	492,881.00	0.25
84	601800	中国交建	67,013	491,875.42	0.25
85	601985	中国核电	118,300	483,847.00	0.25
86	600606	绿地控股	69,400	428,892.00	0.22
87	601066	中信建投	9,700	381,986.00	0.19
88	601111	中国国航	56,740	375,051.40	0.19
89	002607	中公教育	12,900	357,975.00	0.18
90	601360	三六零	19,300	353,383.00	0.18
91	601816	京沪高铁	56,000	348,880.00	0.18
92	003816	中国广核	112,100	331,816.00	0.17
93	601998	中信银行	58,235	299,910.25	0.15
94	601881	中国银河	24,500	281,015.00	0.14
95	600018	上港集团	66,025	277,305.00	0.14
96	601319	中国人保	40,500	260,820.00	0.13
97	601658	邮储银行	51,000	233,070.00	0.12
98	601238	广汽集团	17,640	158,760.00	0.08
99	600025	华能水电	34,200	129,618.00	0.07

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688177	百奥泰	6,556.00	373,823.12	0.19
2	688228	开普云	1,522.00	111,410.40	0.06

3	688277	天智航	8,502.00	102,364.08	0.05
4	688528	秦川物联	7,346.00	83,230.18	0.04
5	688377	迪威尔	4,872.00	79,998.24	0.04
6	688027	国盾量子	2,122.00	76,773.96	0.04
7	688600	皖仪科技	4,693.00	72,741.50	0.04
8	603087	甘李药业	559.00	56,067.70	0.03
9	300842	帝科股份	455.00	18,527.60	0.01
10	600956	新天绿能	2,533.00	12,766.32	0.01
11	300839	博汇股份	502.00	11,751.82	0.01
12	300845	捷安高科	470.00	8,286.10	0.00
13	300843	胜蓝股份	751.00	7,517.51	0.00
14	300840	酷特智能	1,185.00	7,038.90	0.00
15	300846	首都在线	1,131.00	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002714	牧原股份	2,013,161.00	0.91
2	601398	工商银行	1,306,584.00	0.59
3	603160	汇顶科技	734,554.00	0.33
4	601688	华泰证券	482,791.00	0.22
5	002352	顺丰控股	448,679.00	0.20
6	601229	上海银行	429,612.00	0.19
7	000002	万科 A	416,870.00	0.19
8	600585	海螺水泥	380,800.00	0.17
9	002607	中公教育	371,697.00	0.17
10	601816	京沪高铁	356,718.00	0.16
11	003816	中国广核	344,040.00	0.16
12	688266	泽璟制药	327,201.92	0.15
13	300015	爱尔眼科	293,790.00	0.13
14	688169	石头科技	291,725.12	0.13
15	688126	沪硅产业	291,672.20	0.13
16	000725	京东方 A	246,792.00	0.11
17	601766	中国中车	239,418.00	0.11
18	601658	邮储银行	239,058.00	0.11
19	000063	中兴通讯	238,959.00	0.11
20	688158	优刻得	229,287.00	0.10

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	2,108,580.00	0.95
2	600519	贵州茅台	1,425,386.32	0.65
3	601166	兴业银行	1,250,354.00	0.57
4	601288	农业银行	944,431.00	0.43
5	600036	招商银行	896,773.00	0.41
6	601336	新华保险	816,641.00	0.37
7	600016	民生银行	745,815.00	0.34
8	600276	恒瑞医药	737,963.00	0.33
9	688126	沪硅产业	726,556.20	0.33
10	000651	格力电器	716,066.00	0.32
11	600958	东方证券	711,929.00	0.32
12	000858	五粮液	655,402.00	0.30
13	000333	美的集团	622,171.00	0.28
14	688266	泽璟制药	601,873.20	0.27
15	600010	宝钢股份	535,507.64	0.24
16	688169	石头科技	483,448.65	0.22
17	600887	伊利股份	476,362.00	0.22
18	688158	优刻得	468,100.90	0.21
19	688298	东方生物	447,158.00	0.20
20	688200	华峰测控	438,480.00	0.20

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	15,659,802.34
卖出股票的收入（成交）总额	43,587,036.94

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除中信证券和兴业银行外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司，因其在保荐上海柏楚电子科技股份有限公司科创板首次公开发行股票申请过程中，对前期间询要求披露的相关内容在招股说明书注册稿（6月28日）中擅自进行了删减，于2019年7月16日被证监会决定采取出具警示函的监督管理措施。兴业银行（601166）的发行主体是兴业银行股份有限公司，其沈阳分公司因严重违反审慎经营规则办理票据业务，于2019年10月15日被辽宁银保监局罚款2250万元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,886.50
2	应收证券清算款	388,459.26
3	应收股利	-
4	应收利息	2,645.27
5	应收申购款	9,014.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	409,005.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688177	百奥泰	373,823.12	0.19	新股锁定
2	688228	开普云	111,410.40	0.06	新股锁定
3	688277	天智航	102,364.08	0.05	新股待上市
4	688528	秦川物联	83,230.18	0.04	新股待上市
5	688377	迪威尔	79,998.24	0.04	新股待上市

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数(户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额 比例
国联安双禧 A 中证 100 指数	536	48,976.50	10,277,841.00	39.15%	15,973,563.00	60.85%
国联安双禧 B 中证 100 指数	2,882	13,663.12	574.00	0.00%	39,376,532.00	100.00%
国联安双禧中 证 100 指数	5,325	20,717.58	68,907,056.16	62.46%	41,414,069.11	37.54%
合计	8,743	20,124.63	79,185,471.16	45.00%	96,764,164.11	55.00%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 期末上市基金前十名持有人

国联安双禧 A 中证 100 指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈宏和	2,718,639.00	10.36%
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募）	2,005,246.00	7.64%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	1,800,000.00	6.86%
4	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	1,799,600.00	6.86%
5	王雁	1,749,900.00	6.67%

6	中国银河证券股份有限公司	1,444,362.00	5.50%
7	北京磐沅投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沅固收增强私募证券投资基金	1,409,029.00	5.37%
8	郭宝海	1,009,091.00	3.84%
9	吴刚	1,000,000.00	3.81%
10	关春艳	895,883.00	3.41%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双禧B中证100指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张俊生	6,000,000.00	15.24%
2	张阳光	850,470.00	2.16%
3	张俊英	814,534.00	2.07%
4	柴旭麟	737,235.00	1.87%
5	韦桂生	729,752.00	1.85%
6	王瑛	608,000.00	1.54%
7	郑元岳	600,000.00	1.52%
8	孙英	508,001.00	1.29%
9	王爽	501,801.00	1.27%
10	朱凯	452,600.00	1.15%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安双禧 A 中证 100 指数	3,514.91	0.01%
	国联安双禧 B 中证 100 指数	-	-
	国联安双禧中证 100 指数	-	-
	合计	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安双禧 A 中证 100 指数	国联安双禧 B 中证 100 指数	国联安双禧中证 100 指数
基金合同生效日（2010 年 4 月 16 日）基金份额总额	263,081,728.00	394,622,592.00	324,434,577.44
本报告期期初基金份额总额	28,952,968.00	43,429,452.00	130,388,330.80
本报告期基金总申购份额	-	-	465,562.78
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	27,286,678.31
本报告期基金拆分变动份额	-2,701,564.00	-4,052,346.00	6,753,910.00
本报告期末基金份额总额	26,251,404.00	39,377,106.00	110,321,125.27

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金定期份额折算变动份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2020 年 4 月 25 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，孟朝霞女士不再担任公司总经理职务，由常务副总经理兼投资总监魏东先生代行总经理职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	28,120,509.93	53.17%	26,082.84	53.21%	-
东兴证券股份 有限公司	1	18,326,833.71	34.65%	17,067.76	34.82%	-
华创证券有限 责任公司	1	5,775,909.75	10.92%	5,263.60	10.74%	-
东北证券股份 有限公司	1	664,772.55	1.26%	605.78	1.24%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 研究报告被基金采纳的情况；

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；

E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内租用证券公司交易单元无变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2019 年第四季度报告	指定网站、深圳证券交易所	2020-01-18
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2019	中国证券报、上海证券	2020-01-18

	年第 4 季度报告提示性公告	报、证券时报、证券日报	
3	国联安基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、指定网站	2020-01-30
4	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、指定网站	2020-02-28
5	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源及申万宏源西部相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、指定网站	2020-03-04
6	国联安基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、指定网站	2020-03-16
7	国联安基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、指定网站	2020-03-20
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、指定网站	2020-03-23
9	国联安基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、指定网站	2020-03-23
10	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2020-04-14
11	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2020-04-21
12	国联安基金管理有限公司 2020 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2020-04-22
13	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2020 年第一季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2020-04-22
14	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为代销机构并参加其费率优惠的公告	规定报刊、规定网站	2020-04-24
15	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2020-04-25
16	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华安证券为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2020-04-27
17	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金 2019 年年度报告	规定网站、深圳证券交易所	2020-04-30
18	国联安基金管理有限公司 2019 年年度报告提示性公告	规定报刊	2020-04-30

19	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2020-05-06
20	国联安基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同及托管协议的公告	规定报刊、规定网站	2020-05-26
21	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同	规定网站	2020-05-26
22	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金托管协议	规定网站	2020-05-26
23	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)正文	规定网站	2020-05-29
24	国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要	规定网站	2020-05-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

自 2020 年 4 月 23 日起，孟朝霞女士不再担任公司总经理，由常务副总经理兼投资总监魏东先生代行总经理职务。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日